

وضعیت بازار سرمایه در هفته منتهی به ۱۴۰۰/۶/۲۴

در آخرین روز معاملاتی هفته گذشته اگرچه در ابتدا تحرکات مثبتی در برخی شاخص‌سازها به چشم خورد، اما شاهد آغاز به کار متعادل همراه با نوسانات منفی در کلیت بازار سهام بودیم. با ادامه روند نزولی بازار نهایتاً شاخص کل با افت ۸،۶۶۶ واحد به سطح ۱،۴۸۸،۲۹۷ واحد رسید. شستا، فولاد و اخبر بیشترین تاثیر منفی را بر شاخص کل داشتند.

هرچند که تنها اخبر با صف فروش به کار خود پایان داد. در انتهای معاملات خودروبی‌ها از گروه‌هایی بودند که در آن‌ها گرایش مثبت بر گرایش منفی برتری داشتند. کوچکترهای بازار نیز همسو با بزرگان بازار با اصلاحات زیادی همراه بودند و نوسانات منفی را در آخرین روز معاملاتی هفته گذشته تجربه کردند. با این حساب شاخص هم وزن نیز با افت ۱،۴۴۹ واحدی در ایستگاه ۴۵۰،۴۵۹،۷۹ واحد متوقف شد.

در هفته‌ای که گذشت در بیشتر روزها بازار بورس با روند اصلاحی روبرو شد. اگرچه در روز چهارشنبه شاخص کل افتی ۰،۶ درصدی را تجربه کرد، اما حضور همزمان خریداران و وجود تکانه‌های مثبت همراه با نوسانات منفی در بازار موجب گشت تا شاهد تشکیل صف‌های فروش در عمده نمادهای معاملاتی بازار نبوده و اغلب شاخص‌سازها در نزدیکی صفر معاملاتی به کار خود پایان دهند.

نکته قابل توجه طی بازار روز چهارشنبه، افزایش حمایت سرمایه‌گذاران حقوقی از نمادهای بزرگ و شاخص‌ساز همچون نمادهای گروه فرآورده‌های نفتی و پالایشی و گروه استخراج کانه‌های فلزی بود چنانکه در نماد کچاد بیش از ۶۵ درصد، در نماد کگل بیش از ۸۷ درصد، در نماد کگهر بیش از ۸۵ درصد، در نماد شپنا بیش از ۵۵ درصد، در نماد شتران بیش از ۴۲ درصد و در نماد شسپا بیش از ۳۲ درصد از سهام مورد معامله توسط حقوقی‌ها خریداری شد که این موضوع باعث پایان کار این گروه از نمادها با معاملاتی متعادل و عدم تشکیل صف‌های فروش در آن‌ها شد.

طی این روز نمادهای شستا با تأثیر ۹۲۰،۷ واحد، نماد فولاد با تأثیر ۶۵۷،۶ واحد، نماد اخبر با تأثیر ۶۴۳،۴ واحد و نماد فملی با تأثیر ۵۴۸،۶ واحد بیشترین تأثیر منفی را بر شاخص کل داشتند. بیشترین تأثیر مثبت نیز مربوط به نمادهای پارس با تأثیر ۳۳۹،۶ واحد، نماد وبملت با تأثیر ۱۸۵،۸۷ واحد، نماد شیریز با تأثیر ۱۷۷،۱ واحد و نماد تایرا با تأثیر ۱۱۰،۹ واحد بود. کمترین مقدار ثبت شده شاخص کل طی بازار روز چهارشنبه ۱۴۸۸۲۹۷،۱ واحد و بیشترین مقدار آن نیز ۱۴۹۷۳۷۴،۶ واحد گزارش شده است.

روند اصلاحی شکل گرفته در هفته پیش نشان داد که بازار با ابهاماتی نظیر آینده برجام و بالطبع آن نرخ دلار، سیاست‌های اقتصادی دولت جدید و تعیین مواضع آن در قبال صنایع مختلف مانند خودرو، اظهارنظرهای متناقض پیرامون قیمت گذاری‌های دستوری، گمانه زنی‌ها پیرامون انتشار اوراق بدهی، شایعات در مورد اصلاح قیمت حامل‌های انرژی و فشار فروش احتمالی ایجاد شده پس از آزادسازی سهام عدالت روبرو است و به آن‌ها واکنش نشان داده است که نتیجه آن افت حدود ۲،۵ درصدی شاخص کل در هفته گذشته است.

در کنار این‌ها باید این نکته را نیز در نظر داشت که در صورت انتشار گزارش‌های ۶ ماهه مثبت از سوی شرکت‌ها در روزهای پیش‌رو، بازار برای ادامه روند صعودی مشتاق‌تر شود. هرچند که به اعتقاد بسیاری از کارشناسان با توجه به چشم انداز تورمی موجود، این اصلاح موقتی بوده و بهترین زمان برای اصلاح پورتفوی سهامداران و خرید سهم‌های جذاب از سوی آن‌ها می‌باشد. با وجود این‌ها، به نظر می‌رسد که احتمالاً در روز آتی نیز دست کم در ابتدای بازار با حضور سمت عرضه روبرو باشیم.

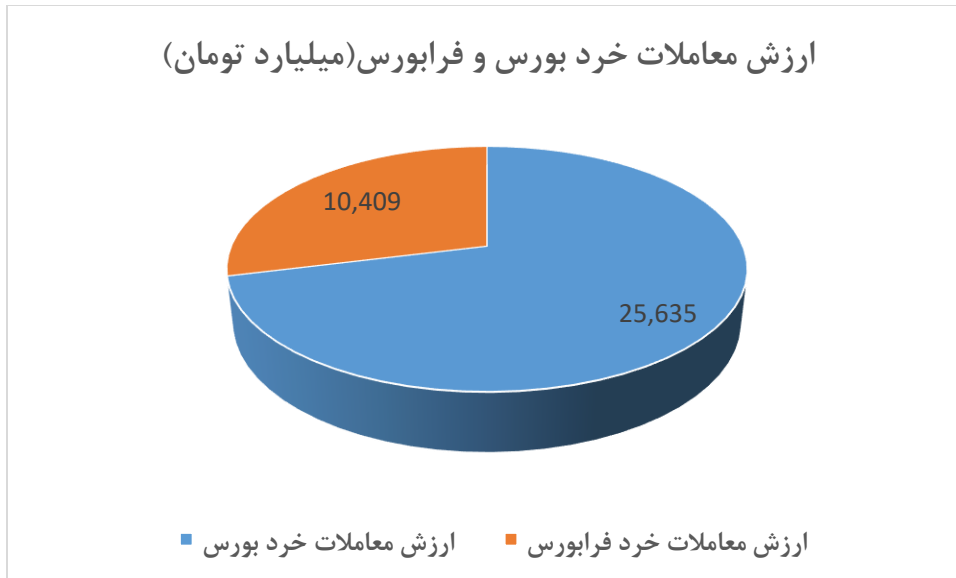
با توجه به اصلاحات اخیر، افزایش ارزش معاملات در روز چهارشنبه و افزایش ۲ درصدی میانگین هفتگی آن، در صورتی که نرخ دلار افزایشی باشد، سمت تقاضا می تواند در ادامه بازار فعال ظاهر شده و بازار را با تحرکات مثبت روبرو کند.

خلاصه اتفاقات بازار (شاخص ها)			
آخرین وضعیت شاخص ها	پایان معاملات روز قبل	پایان معاملات امروز	میزان تغییرات (واحد) / میزان تغییرات (درصد)
شاخص کل	۱,۴۹۶,۹۶۲	۱,۴۸۸,۲۹۷	۸,۶۶۵ / -۰.۵۸%
شاخص هم وزن	۴۵۱,۹۰۸	۴۵۰,۴۵۹	۱,۴۴۹ / -۰.۳۳%
شاخص فرابورس	۲۲,۲۴۵	۲۱,۹۹۸	۲۴۷ / -۱.۱۱%
نمادهای تاثیرگذار			
نمادهای موثر در رشد TEPIX	پارس-وبملت-شبریز	نمادهای موثر در رشد IFX	فجهان-اتکای-قچار
نمادهای موثر در افت TEPIX	شستا-فولاد-اخابر-فملی	نمادهای موثر در افت IFX	بیاس-صبا-وسپهر
شاخص صنایع مثبت	سایر معادن-محصولات چرمی-انتشاروچاپ-وسایل ارتباطی-سایر مالی-کاشی و سرامیک-استخراج نفت		
شاخص صنایع منفی	اکثر صنایع		
روند شاخص	از ابتدا تا انتهای ساعت معاملات نزولی		
بازار P/E	۹.۸۱		
بازار P/S	۳.۷		
نرخ ارز	۲۷,۴۱۰	ارزش دلاری کل بازار (میلیارد دلار)	۲۶۲

آمار معاملات	
ارزش کل معاملات بورس و فرابورس (با در نظر گرفتن اوراق، صندوق ها و بلوک ها)	۳۵,۵۷۴
ارزش معاملات خرد بورس	۴,۴۱۰
ارزش معاملات خرد فرابورس	۱,۸۹۲
ارزش کل معاملات خرد (بدون بلوک ها، اوراق مشارکت و صندوق با درآمد ثابت)	۶,۳۰۲
ارزش کل معاملات معاملات بلوکی، اوراق و صندوق های درآمد ثابت	۲۹,۲۷۲
درصد تغییرات در ارزش معاملات نسبت به روز گذشته	
ارزش معاملات خرد روز کاری گذشته	۶,۹۲۴
درصد تغییرات	-۹%
سهام بازار از ارزش معاملات ۴ نماد برتر	
پالایش-دارایکم-برکت-شستا	۶۴۰
سهام ۴ نماد برتر از کل ارزش معاملات	۱۰%
(ورود/خروج) نقدینگی (میلیارد تومان)	(۴۲۴)

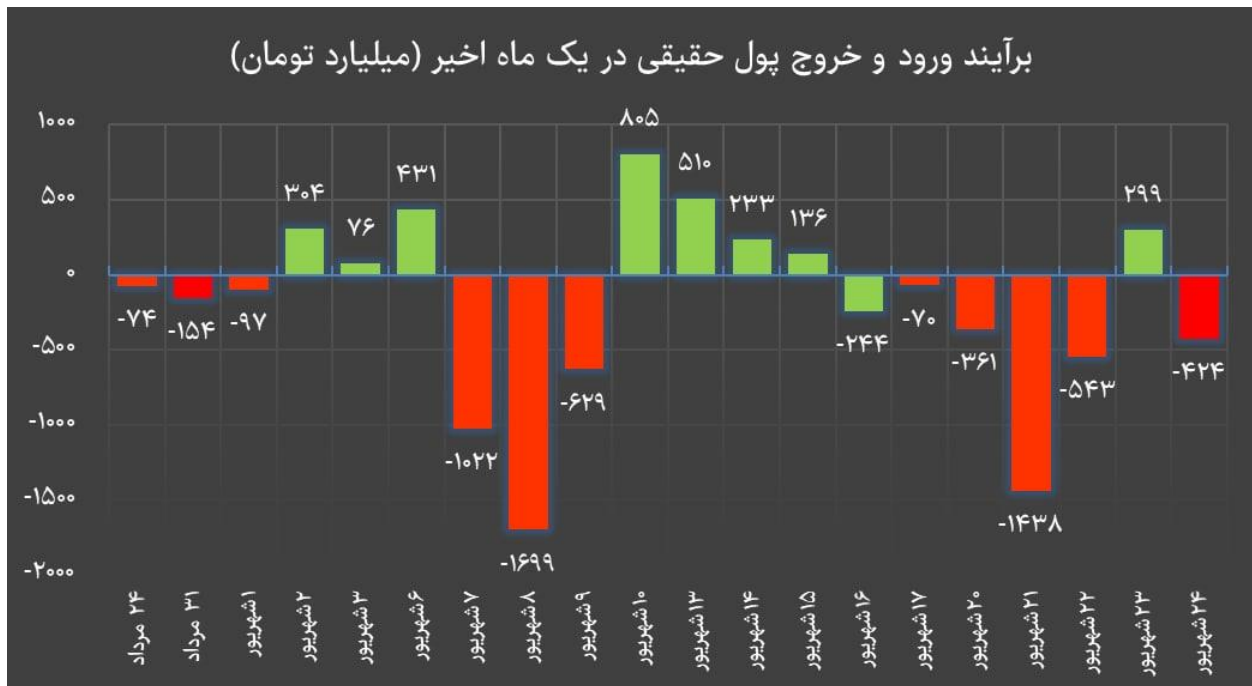
ارزش معاملات خرد در بورس تهران ۳۰ درصد افت کرد. مرور متغیر بااهمیت ارزش معاملات بازار سرمایه در هفته سپری شده نشان می دهد که ۳۶۰۴۴ میلیارد تومان معامله خرد در بورس و فرابورس انجام شده که ۳۰ درصد کمتر از هفته قبل است.

ارزش معاملات خرد بورس و فرابورس (میلیارد تومان)



روند بازار هفته گذشته دقیقاً معکوس روند معاملات هفته سوم بود. این وضعیت نشان می‌دهد که بازار نه میلی به کاهش جدی و توانی برای جهش جدی قیمت‌ها دارد. نکته مهم اینکه، شهریور ماه در حال خاتمه یافتن است و به زودی گزارش عملکرد ماهانه شرکت‌ها از راه خواهد رسید. با انتشار این گزارش‌ها عملاً پرونده تولید و فروش شرکت‌ها در فصل تابستان بسته خواهد شد و تحلیلگران با در دست داشتن این اطلاعات می‌توانند تخمین نزدیکی از سود محقق شده شرکت‌ها در دومین فصل سال داشته باشند. بنابراین یک مهر ماه پر حادثه از ۳ ناحیه کدال، تحولات اقتصادی و اخبار سیاسی در انتظار بازار خواهد بود. لذا طبیعی است که بازار کمی دست به عصا حرکت کند اما به نظر می‌رسد روند معاملات در هفته پایانی شهریور ماه سر و شکل بهتری داشته باشد و شاخص کل بتواند مقداری از افت هفته گذشته را جبران نماید. برای امروز احتمالاً همان بی‌رمقی بازار چهارشنبه را داشته باشیم اما انتظار می‌رود به مرور شاهد تقویت سمت تقاضا و حرکت رو به جلوی بازار باشیم.

برآیند ورود و خروج پول حقیقی در یک ماه اخیر (میلیارد تومان)

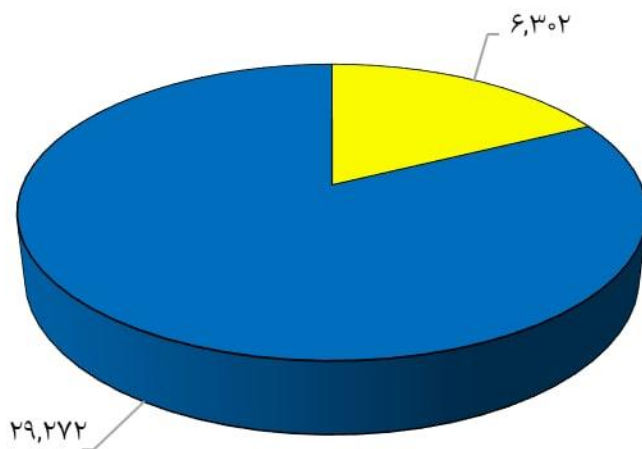


در آخرین روز معاملاتی هفته گذشته و در پیش گشایش بازار، از ۶۳۶ نماد حدود ۵۶ نماد با صف خرید و حدود ۳۵ نماد نیز با صف فروش رو به رو بودند.

تغییرات بازارهای جهانی در هفته منتهی به ۱۴۰۰/۶/۲۶

درصد تغییرات	تاریخ		واحد	نام محصول
	۱۴۰۰/۶/۲۶	۱۴۰۰/۶/۲۰		
۳,۳۳٪	\$ ۷۵,۳۱	\$ ۷۲,۸۸	بشکه/دلار	نفت برنت
-۱,۸۵٪	\$ ۱,۷۵۵	\$ ۱,۷۸۸	مئقال/دلار	طلا
-۵,۲۹٪	\$ ۲,۱۸۴	\$ ۲,۳۰۶	تن/دلار	سرب
-۲۱,۵۴٪	\$ ۱۰۲	\$ ۱۳۰	تن/دلار	سنگ آهن
-۱,۴۱٪	\$ ۳,۰۶۸	\$ ۳,۱۱۲	تن/دلار	روی
-۱,۷۸٪	\$ ۲,۸۷۳	\$ ۲,۹۲۵	تن/دلار	آلمینیوم
۱,۲۰٪	\$ ۳۳۷	\$ ۳۳۳	تن/دلار	متانول
-۴,۳۸٪	\$ ۹,۲۶۴	\$ ۹,۶۸۸	تن/دلار	مس
-۴,۶۱٪	\$ ۶۰۰	\$ ۶۲۹	تن/دلار	بیلت
۶,۶۴٪	\$ ۴۸۲	\$ ۴۵۲	تن/دلار	اوره

ارزش معاملات خرد و بلوکی



- ارزش کل معاملات خرد (بدون بلوک‌ها، اوراق مشارکت و صندوق با درآمد ثابت) ۶,۳۰۲
- ارزش کل معاملات معاملات بلوکی، اوراق و صندوق‌های درآمد ثابت ۲۹,۲۷۲